

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN II	iii
KATA PENGANTAR	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR SIMBOL.....	x
DAFTAR TABEL.....	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	4
1.3 Batasan Masalah	4
1.4 Tujuan Penelitian	5
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	6
2.1 Emas.....	6
2.2 Analisis Runtun Waktu	6
2.3 Stasioneritas Deret Waktu.....	7
2.3.1 Stasioneritas Dalam Varians	8
2.3.2 Stasioneritas Dalam <i>Mean</i>	14
2.4 Fungsi Autokorelasi dan Fungsi Autokorelasi Parsial.....	16
2.4.1 Fungsi Autokorelasi (ACF).....	16

2.4.2	Fungsi Autokorelasi Parsial (PACF).....	17
2.5	Model Umum Runtun Waktu.....	19
2.5.1	Model <i>Autoregressive</i> (AR).....	19
2.5.2	Model <i>Moving Average</i> (MA).....	20
2.5.3	Model <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA).....	21
2.5.4	Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA)	21
2.5.5	Model Subset ARIMA	22
2.6	Identifikasi Model.....	23
2.7	Estimasi Parameter.....	23
2.8	Uji Signifikansi Parameter.....	30
2.9	Uji Asumsi Model.....	31
2.9.1	Uji Normalitas Residual.....	32
2.9.2	Uji Independensi Residual	33
2.10	Uji <i>Autoregressive Conditional Heteroscedasticity Lagrange Multiplier</i> (ARCH-LM)	35
2.11	Model <i>Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity</i> (GARCH).....	36
2.11.1	Estimasi Parameter GARCH.....	37
2.11.2	Uji Signifikansi Parameter Model GARCH.....	41
2.12	Pemilihan Model Terbaik	42
2.13	Peramalan (<i>Forecasting</i>).....	43
BAB III METODE PENELITIAN.....		45
3.1	Jenis dan Sumber Data.....	45
3.2	Variabel Penelitian.....	45
3.3	Tahapan Analisis Data	45
3.4	Diagram Alir Analisis Data	48
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		50

4.1	Analisis Deskriptif Data.....	50
4.2	Stasioneritas Data.....	52
4.2.1	Stasioneritas dalam Varians	52
4.2.2	Stasioneritas dalam <i>Mean</i>	52
4.3	Identifikasi Model ARIMA.....	54
4.4	Estimasi dan Uji Signifikansi Parameter Model ARIMA.....	55
4.5	Uji Asumsi Model.....	64
4.5.1	Uji Normalitas Residual	64
4.5.2	Uji Independensi Residual	66
4.6	Pemilihan Model ARIMA Terbaik	70
4.7	Uji <i>Lagrange Multiplier</i> Model ARIMA.....	71
4.8	Estimasi dan Uji Signifikansi Parameter Model GARCH.....	72
4.9	Pemilihan Model ARIMA-GARCH Terbaik.....	74
4.10	Uji <i>Lagrange Multiplier</i> Model ARIMA-GARCH.....	75
4.11	Peramalan Data <i>Out-Sample</i> dan Evaluasi Model	75
4.12	Peramalan Harga Emas Dunia Periode Mendatang	80
BAB V PENUTUP.....		81
5.1	Kesimpulan	81
5.2	Saran	82
DAFTAR PUSTAKA		83
LAMPIRAN.....		86